

**PERBANDINGAN *RETURN* SAHAM DAN VOLUME
PERDAGANGAN SAHAM SEBELUM DAN SESUDAH
PENGUMUMAN PENGEMBANGAN VAKSIN COVID-19 PADA
PERUSAHAAN SEKTOR FARMASI YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA**

SKRIPSI

Program Studi: Manajemen



Oleh :

Nama : Windy Putri Marchelina

NIM : 041701503125033

**FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA
JAKARTA**

2021

**PERBANDINGAN *RETURN* SAHAM DAN VOLUME
PERDAGANGAN SAHAM SEBELUM DAN SESUDAH
PENGUMUMAN PENGEMBANGAN VAKSIN COVID-19 PADA
PERUSAHAAN SEKTOR FARMASI YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA**

SKRIPSI

**Diajukan Sebagai Salah Satu Syarat Untuk Memperoleh Gelar
SARJANA MANAJEMEN
Program Studi Manajemen – Strata 1**



Oleh:

Nama : Windy Putri Marchelina

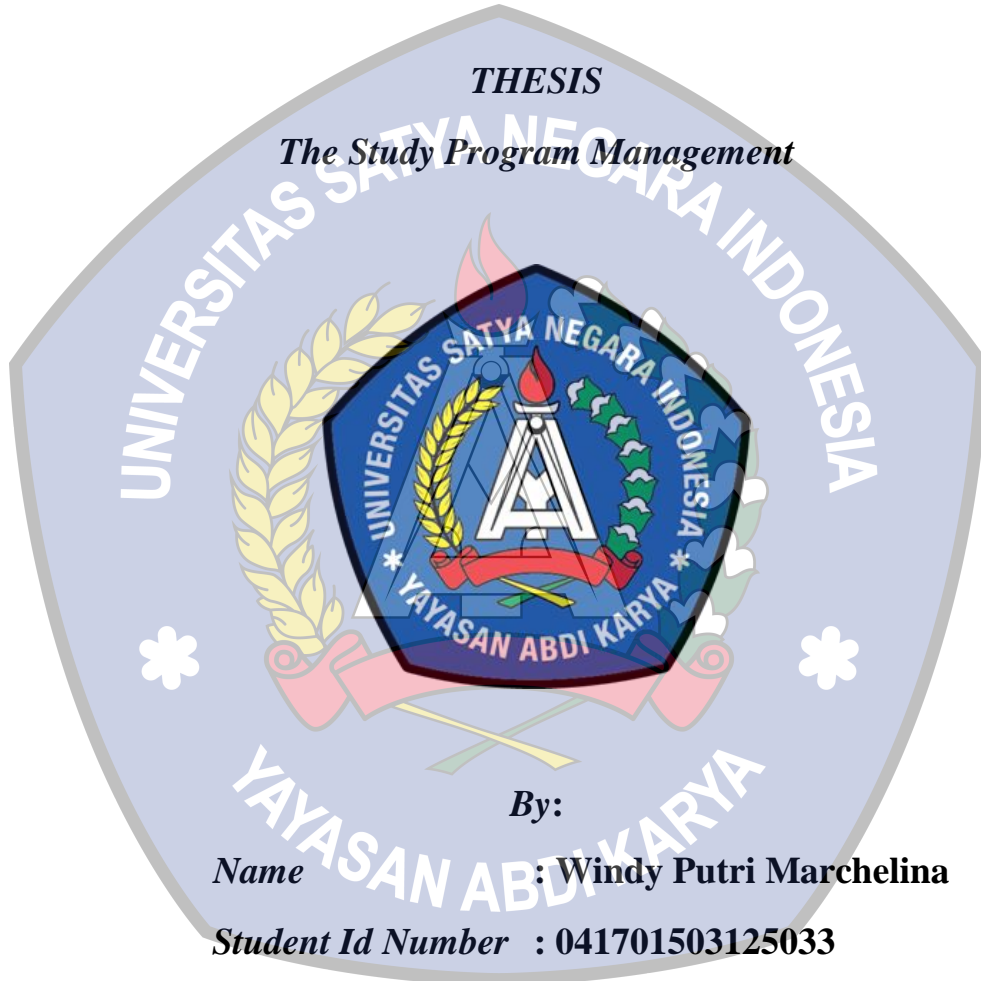
NIM : 041701503125033

**FAKULTAS EKONOMI & BISNIS
UNIVERSITAS SATYA NEGARA INDONESIA
JAKARTA
2021**

***COMPARISON OF SHARE RETURN AND STOCK TRADING
VOLUME BEFORE AND AFTER THE ANNOUNCEMENT OF THE
DEVELOPMENT OF THE COVID-19 VACCINE IN
PHARMACEUTICAL SECTOR COMPANIES LISTED ON THE
INDONESIA STOCK EXCHANGE***

THESIS

The Study Program Management



By:

Name : Windy Putri Marchelina

Student Id Number : 041701503125033

***FACULTY ECONOMIC & BUSINESS
SATYA NEGARA INDONESIA UNIVERSITY
JAKARTA***

2021

***COMPARISON OF SHARE RETURN AND STOCK TRADING
VOLUME BEFORE AND AFTER THE ANNOUNCEMENT OF THE
DEVELOPMENT OF THE COVID-19 VACCINE IN
PHARMACEUTICAL SECTOR COMPANIES LISTED ON THE
INDONESIA STOCK EXCHANGE***

THESIS

***Submitted as one of the requirements for obtaining a degree
BACHELOR IN MANAGEMENT
Management Study Program – Undergraduate 1***



By:

Name : Windy Putri Marchelina

Student Id Number : 041701503125033

***FACULTY ECONOMIC & BUSINESS
SATYA NEGARA INDONESIA UNIVERSITY***

JAKARTA

2021

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI

Yang Bertanda Tangan Dibawah Ini :

Nama : Windy Putri Marchelina

NIM : 041701503125033

Program Studi : Manajemen

Menyatakan bahwa hasil skripsi ini adalah murni hasil karya sendiri dan seluruh isi skripsi menjadi tanggung jawab saya sendiri. Apabila saya mengutip dari karya orang lain maka saya mencantumkan sumber yang sesuai dengan ketentuan yang berlaku. Saya bersedia dikenai sanksi pembatalan skripsi ini apabila terbukti melakukan tindakan plagiat (penjiplakan).

Demikian pernyataan ini saya buat dengan sebenarnya.

Jakarta, 30 Juli 2021



(Windy Putri Marchelina)

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI

NAMA : Windy Putri Marchelina

NIM : 041701503125033

JURUSAN : Manajemen

KONSENTRASI : Keuangan

JUDUL SKRIPSI : PERBANDINGAN *RETURN* SAHAM DAN VOLUME PERDAGANGAN SAHAM SEBELUM DAN SESUDAH PENGUMUMAN PENGEMBANGAN VAKSIN COVID-19 PADA PERUSAHAAN SEKTOR FARMASI YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA

TANGGAL UJIAN : 23 Agustus 2021

Jakarta, 4 Agustus 2021

Dosen Pembimbing II

Dosen Pembimbing I

(Dr. Arifin Siagian, SE., MM)

(Dr. Yosi Stefhani, SE., MM)

Dekan

Ketua Jurusan

(GL. Hery Prasetya, SE., MM)

(Yuslinda Nasution, SE., MM)

LEMBAR PENGESAHAN PENGUJI

**PERBANDINGAN *RETURN* SAHAM DAN VOLUME
PERDAGANGAN SAHAM SEBELUM DAN SESUDAH
PENGUMUMAN PENGEMBANGAN VAKSIN COVID-19 PADA
PERUSAHAAN SEKTOR FARMASI YANG TERDAFTAR DI
BURSA EFEK INDONESIA**

OLEH:

NAMA : Windy Putri Marchelina

NIM : 041701503125033

Telah dipertahankan didepan penguji pada tanggal 23 agustus 2021 dan dinyatakan telah memenuhi syarat diterima.

Ketua Penguji / Pembimbing I



(Dr. Yosi Stefhani, SE., MM)

Anggota Penguji



(Yuslinda Nasution, SE., MM)

Anggota Penguji



(Dr. Darlius, SE., MM)

KATA PENGANTAR

Puji Syukur penulis panjatkan kehadirat Allah SWT atas rahmat dan karunia yang telah diberikan kepada penulis sehingga dapat menyelesaikan skripsi yang berjudul **“Perbandingan *Return Saham* Dan *Volume Perdagangan Saham* Sebelum Dan Sesudah Pengumuman Pengembangan Vaksin Covid-19 Pada Perusahaan Sektor Farmasi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia”**

Skripsi ini merupakan syarat untuk memperoleh gelar sarjana pada Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi & Bisnis Universitas Satya Negara Indonesia.

Penulis mengucapkan terima kasih sebesar-besarnya kepada semua pihak yang tidak dapat disebutkan satu persatu, yang telah memberikan bantuan baik secara moril maupun materil sehingga skripsi ini dapat selesai. Selain itu, penulis mengucapkan terima kasih kepada:

1. Rektor Universitas Satya Negara Indonesia, Ibu Dra. Merry L. Panjaitan, MM., MBA.
2. Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Satya Negara Indonesia, Bapak GL. Herry Prasetya, SE., MM.
3. Ketua Jurusan Manajemen Ibu Yuslinda Nasution, SE., MM
4. Ibu Dr. Yosi Stefhani, SE., MM selaku Dosen Pembimbing I yang telah banyak meluangkan waktu, tenaga, dan pikiran untuk memberikan pengarahan dan bimbingan kepada penulis dalam menyusun skripsi.

5. Bapak Dr. Arifin Siagian, SE., MM selaku Dosen Pembimbing Akademik dan Dosen Pembimbing II yang telah memberikan arahan, motivasi, serta memberikan saran kepada penulis dalam penyusunan skripsi.
6. Bapak, Ibu Dosen Fakultas Ekonomi & Bisnis Jurusan Manajemen yang telah memberikan bekal ilmu pengetahuan yang bermanfaat bagi penulis.
7. Untuk keluarga penulis, Atmadja dan Jaronah selaku Orang tua Penulis, Basilan, Mulyati dan almh. Afsah selaku kakek dan nenek penulis, Andi Putra Ramadhan selaku abang penulis, Ivan Raditya Arifin selaku adik penulis, yang selalu memberikan dukungan dan doa yang tiada henti sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi ini.
8. Teman seperjuangan Yuni Oktaviani, Mardiana, Ainiyah Rizki, Niken Aprilia, Devi Yanti, Shisi Fazriah, Lulu Mahmudah dan Dian Kartini yang sama-sama membantu, memberi semangat hingga skripsi ini dapat selesai dengan baik dan lancar.
9. Rikky Sania Ristandi, Lifia Ramadhani, Eva Choirunnisa, Nadia Friska, Lulu Iqfi, Vara Febri, dan Dwi Ajeng yang selalu memberi dukungan dan semangat.
10. Teman-teman Fakultas Ekonomi & Bisnis 2017 yang sudah sama-sama berjuang dan membantu selama dibangku perkuliahan. Pelajaran dan kenangan menjadi bekal dan cerita saya kelak.
11. Untuk teman-teman gedung D yang selalu memberikan hiburan dan keceriaan selama dibangku perkuliahan.

Penulis dengan ini menyadari masih banyak kekurangan dalam penyusunan skripsi ini, tanpa kalian semua mungkin saya bukan apa-apa. Untuk itu maka penulis dengan senang hati menerima berbagai masukan, saran, kritik yang membangun demi kesempurnaan penulisan dimasa yang akan datang. Penulis berharap laporan ini dapat bermanfaat bagi pembaca dan pengembangan ilmu.

Jakarta, 30 Juli 2021



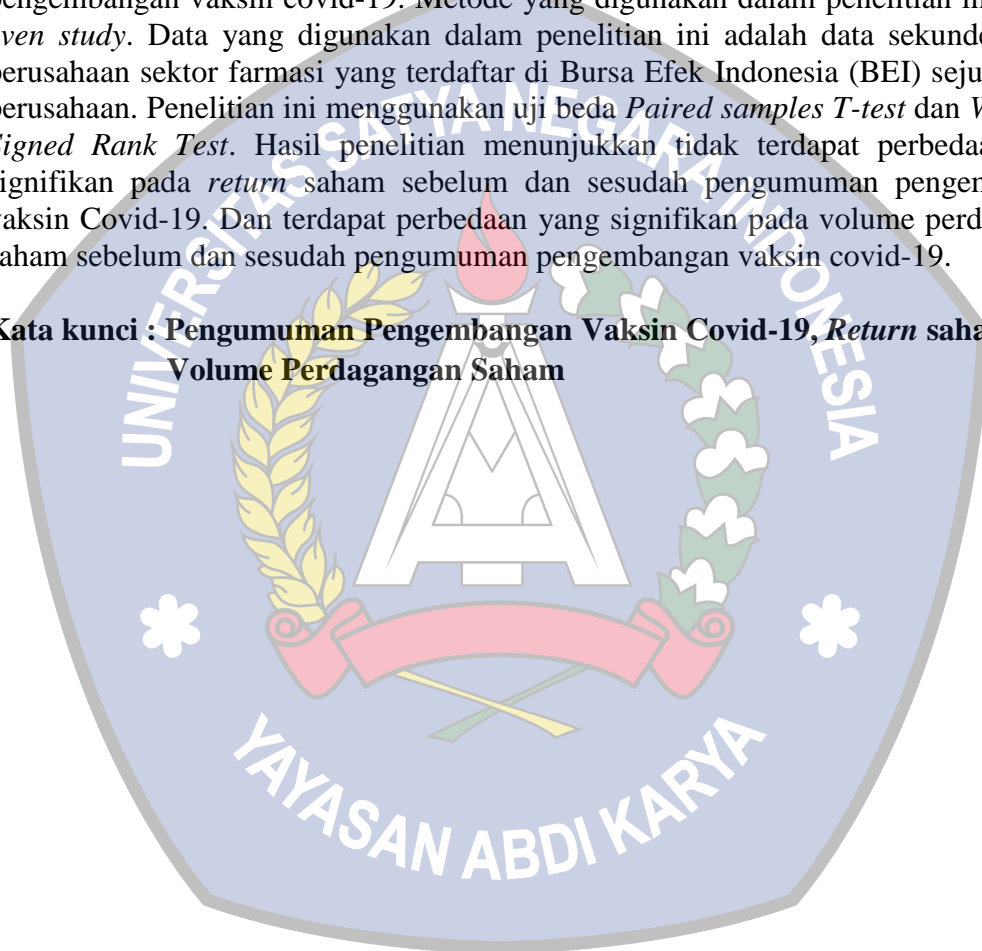
Windy Putri Marchelina



ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui Perbandingan *Return Saham* Dan Volume Perdagangan Saham Sebelum Dan Sesudah Pengumuman Pengembangan Vaksin Covid-19 Pada Perusahaan Sektor Farmasi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. Waktu untuk menganalisis perbedaan *Return Saham* dan Volume Perdagangan Saham pada periode 10 hari sebelum dan 10 hari sesudah pengumuman pengembangan vaksin covid-19. Metode yang digunakan dalam penelitian ini adalah *even study*. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder yakni perusahaan sektor farmasi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) sejumlah 10 perusahaan. Penelitian ini menggunakan uji beda *Paired samples T-test* dan *Wilcoxon Signed Rank Test*. Hasil penelitian menunjukkan tidak terdapat perbedaan yang signifikan pada *return* saham sebelum dan sesudah pengumuman pengembangan vaksin Covid-19. Dan terdapat perbedaan yang signifikan pada volume perdagangan saham sebelum dan sesudah pengumuman pengembangan vaksin covid-19.

Kata kunci : Pengumuman Pengembangan Vaksin Covid-19, *Return* saham, Volume Perdagangan Saham



ABSTRACT

This study aims to determine the comparison of stock returns and stock trading volume before and after the announcement of the development of the Covid-19 vaccine in pharmaceutical sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange. Time to analyze the difference in Stock Return and Stock Trading Volume in the period of 10 days before and 10 days after the announcement of the development of the covid-19 vaccine. The method used in this research is even study. The data used in this study is secondary data, namely the pharmaceutical sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) with a total of 10 companies. This study uses a different test Paired samples T-test and Wilcoxon Signed Rank Test. The results showed that there was no significant difference in stock returns before and after the announcement of the development of the Covid-19 vaccine. And there is a significant difference in stock trading volume before and after the announcement of the development of the covid-19 vaccine.

Keywords : Covid-19 Vaccine Development Announcement, Stock Return, Stock Trading Volume

